

---

## Microéconométrie avancée

Pierre Dubois

---



### Édition électronique

URL : <https://journals.openedition.org/annuaire-ehess/17883>

ISSN : 2431-8698

### Éditeur

EHESS - École des hautes études en sciences sociales

### Édition imprimée

Date de publication : 1 janvier 2006

Pagination : 661-662

ISSN : 0398-2025

### Référence électronique

Pierre Dubois, « Microéconométrie avancée », *Annuaire de l'EHESS* [En ligne], | 2006, mis en ligne le 01 avril 2015, consulté le 20 mai 2021. URL : <http://journals.openedition.org/annuaire-ehess/17883>

---

Ce document a été généré automatiquement le 20 mai 2021.

EHESS

---

# Microéconométrie avancée

Pierre Dubois

---

Pierre Dubois, *chargé de recherche à l'INRA*

- 1 DANS ce cours, nous avons étudié plusieurs développements récents en microéconométrie concernant l'identification et l'estimation des effets de traitements, des modèles de choix discrets et les méthodes semi-paramétrique d'estimation. Le but est de montrer l'importance des modèles économiques et de leurs interprétations en microéconométrie. Nous insistons sur les questions méthodologiques et les difficultés soulevées par les problèmes d'identification avec des exemples théoriques et appliqués (avec par exemple le problème de « réflexion », les problèmes de mixtures, d'évaluation d'effets de réformes). Des développements récents en microéconométrie ont amélioré notre compréhension des questions de sélection et d'endogénéité en économie appliquée.
- 2 Pour toutes les questions théoriques, nous étudions des exemples économiques importants et applications de la littérature (modèle de Roy appliqué en économie du travail, Impact des programmes de développement et des interventions ciblées, évaluation des programmes d'insertion sur le marché du travail ou d'autres réformes, estimations des rendements de l'éducation...).
- 3 La littérature sur les effets de traitement est récente et a permis de mieux comprendre le rôle précis des coefficients estimés, les hypothèses nécessaires pour leur identification, et leur pertinence pour les politiques économiques. Ces méthodes sont utilisées dans divers contextes où on peut parfois trouver ce que l'on appelle une expérience naturelle ou une expérience contrôlée. Après avoir étudié les définitions des divers paramètres d'intérêt étudiés généralement (effet de traitement moyen, effet de traitement sur les traités, effet de traitement marginal, effet de traitement moyen local), nous avons étudié leurs conditions d'identification (paramétrique ou non-paramétrique) et leurs différentes méthodes d'estimation (variables instrumentales, estimateurs par appariement, appariement par « propensity score », ...) selon le processus de sélection, les hypothèses d'hétérogénéité, ... Les méthodes concernant les effets de traitement sont utilisées dans un grand nombre de domaines de recherche en

général orientées vers la définition des politiques économiques comme l'économie du travail, l'économie du développement, l'économie de la santé, l'économie de l'éducation, l'évaluation de politiques publiques en général, ... Par exemple, elles sont très utiles pour évaluer l'impact de programmes ciblés pour l'éducation, la santé, la réduction de la pauvreté, l'amélioration de l'accès au crédit et du fonctionnement du marché du travail, l'impact de programmes de formation, ainsi que les programmes de prévention en santé.

- 4 Après avoir étudié ces méthodes, nous sommes passés à une seconde partie concernant l'identification et l'estimation des modèles de choix discret. En rappelant les hypothèses et résultats de l'estimation paramétrique des modèles de choix binaire, nous étudions les méthodes semi-paramétriques incluant l'estimateur du score maximum, de rang maximum, les estimateurs de dérivées moyennes, les méthodes valides dans les cas d'indépendance partielle (Lewbel) et leurs liens.

---

## INDEX

**Thèmes :** Économie